N° 11-626-X au catalogue — N° 059
ISSN 1927-5048
ISBN 978-0-660-05448-3

Aperçus économiques

Mobilité intergénérationnelle du revenu : nouvelles données pour le Canada

par Wen-Hao Chen, Yuri Ostrovsky et Patrizio Piraino

Date de diffusion : le 17 juin 2016

Statistique Canada Statistics Canada

Canada

Comment obtenir d'autres renseignements

Pour toute demande de renseignements au sujet de ce produit ou sur l'ensemble des données et des services de Statistique Canada, visiter notre site Web à www.statcan.gc.ca.

Vous pouvez également communiquer avec nous par :

Courriel à STATCAN.infostats-infostats.STATCAN@canada.ca

Téléphone entre 8 h 30 et 16 h 30 du lundi au vendredi aux numéros sans frais suivants :

- Service de renseignements statistiques 1-800-263-1136
- Service national d'appareils de télécommunications pour les malentendants 1-800-363-7629
- Télécopieur 1-877-287-4369

Programme des services de dépôt

- Service de renseignements 1-800-635-7943
- Télécopieur 1-800-565-7757

Normes de service à la clientèle

Statistique Canada s'engage à fournir à ses clients des services rapides, fiables et courtois. À cet égard, notre organisme s'est doté de normes de service à la clientèle que les employés observent. Pour obtenir une copie de ces normes de service, veuillez communiquer avec Statistique Canada au numéro sans frais 1-800-263-1136. Les normes de service sont aussi publiées sur le site www.statcan.gc.ca sous « Contactez-nous » > « Normes de service à la clientèle ».

Note de reconnaissance

Le succès du système statistique du Canada repose sur un partenariat bien établi entre Statistique Canada et la population du Canada, les entreprises, les administrations et les autres organismes. Sans cette collaboration et cette bonne volonté, il serait impossible de produire des statistiques exactes et actuelles.

Signes conventionnels dans les tableaux

Les signes conventionnels suivants sont employés dans les publications de Statistique Canada :

.	indisponible pour toute période de référence
..	indisponible pour une période de référence précise
...	n'ayant pas lieu de figurer
0	zéro absolu ou valeur arrondie à zéro
0^s	valeur arrondie à 0 (zéro) là où il y a une distinction importante entre le zéro absolu et la valeur arrondie
^{p}	provisoire
^{r}	révisé
x	confidentiel en vertu des dispositions de la *Loi sur la statistique*
^{E}	à utiliser avec prudence
F	trop peu fiable pour être publié
*	valeur significativement différente de l'estimation pour la catégorie de référence (p<0,05)

Publication autorisée par le ministre responsable de Statistique Canada

© Ministre de l'Industrie, 2016

Tous droits réservés. L'utilisation de la présente publication est assujettie aux modalités de l'entente de licence ouverte de Statistique Canada.

Une version HTML **est aussi disponible.**

This publication is also available in English.

Mobilité intergénérationnelle du revenu : nouvelles données pour le Canada

par Wen-Hao Chen et Yuri Ostrovsky, Division de l'analyse sociale et de la modélisation
et Patrizio Piraino, Université de Cape Town, Afrique du Sud

Le présent article des *Aperçus économiques* examine la mobilité intergénérationnelle du revenu, c'est-à-dire la mesure dans laquelle le revenu à vie des enfants est corrélé avec le revenu à vie du père. L'analyse repose sur la base de données sur la mobilité intergénérationnelle du revenu de Statistique Canada, dans laquelle les données des enfants et des parents sont couplées à partir des fichiers d'impôt. Les données fournissent des renseignements permettant de comparer le revenu des enfants à celui de leurs parents à une étape comparable du cycle de vie[1].

La mobilité sociale est souvent vue comme une mesure générale de l'égalité des chances. Une société immobile pourrait être définie comme une société dans laquelle toute inégalité observée dans la génération actuelle est transmise aux générations futures, tandis qu'une société mobile est une société dans laquelle les résultats individuels sont déterminés par des facteurs autres que la situation familiale initiale.

L'examen de l'élasticité intergénérationnelle du revenu (EIR) est une façon simple mais intuitive de mesurer la mobilité sociale. On peut estimer l'EIR en comparant les revenus des parents avec ceux de leurs enfants à l'âge adulte. L'élasticité estimée peut prendre une valeur entre zéro et un, une valeur de zéro indiquant que la position des parents et celle de leurs enfants (adultes) dans la répartition du revenu ne sont aucunement liées (c.-à-d. mobilité complète) et une valeur de un, que la position des parents et celle de leurs enfants (adultes) dans la répartition du revenu sont identiques (c.-à-d. immobilité complète). À partir de cet indice, l'une des premières études à ce sujet, réalisée par Corak et Heisz (1999), a montré que le Canada, dont l'EIR estimée se situait autour de 0,2, était l'un des pays les plus mobiles parmi les économies avancées, comme le Danemark, la Finlande et la Norvège.

La présente étude réexamine la mobilité intergénérationnelle des gains et du revenu au Canada à l'aide d'une version actualisée de la base de données sur la mobilité intergénérationnelle du revenu (base de DMIR). Cette base contient des données sur un échantillon de parents et de leurs enfants adolescents et fait le suivi de ces derniers jusqu'à l'âge mûr, plutôt que jusqu'au début de la trentaine, comme l'ont fait Corak et Heisz (1999). En effet, des publications récentes indiquent que la persistance du revenu au fil des générations peut être considérablement sous-évaluée lorsque les revenus des enfants ne sont pas observés jusqu'à la mi-carrière[2].

Des mesures améliorées du revenu des pères sont aussi estimées à partir des données actualisées[3]. L'étude compte près d'un quart de million d'observations et permet également d'examiner les différences de mobilité intergénérationnelle dans l'ensemble de la répartition du revenu. En outre, on estime l'EIR relative aux gains (c.-à-d. les salaires et traitements), au revenu du marché (c.-à-d. les gains plus les revenus d'un travail indépendant et de placements) ainsi qu'au revenu total (c.-à-d. revenu total du marché plus transferts gouvernementaux).

Les Canadiens sont mobiles, mais pas dans la mesure où on le croyait

Calculée à l'aide des mesures améliorées des gains à vie pour les pères et les fils, l'EIR au Canada s'établit à 0,32, ce qui signifie qu'environ 32 % des écarts de gains dans la génération des pères seront transmis à la génération de leurs fils (graphique 1). Le nouveau résultat pour la persistance des gains est supérieur à l'estimation antérieure de Corak et Heisz (1999) pour le Canada, qui s'établissait à environ 20 %. La possibilité d'observer les gains des enfants à la mi-carrière explique environ les deux tiers de la divergence entre les deux études. Bien que l'importance de la persistance des gains au fil des générations soit plus grande qu'on ne le croyait auparavant, elle est quand même relativement modeste si on la compare aux estimations pour de nombreux autres pays développés. Aux États-Unis, par exemple, la mesure équivalente s'établit autour de 40 % à 50 %, selon les études[4].

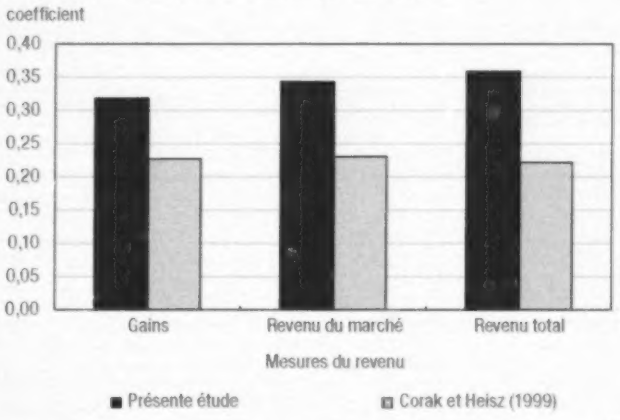
1. Un rapport d'étude plus détaillé a aussi été publié. Voir Chen, Ostrovsky et Piraino (2015).
2. Dans les travaux de recherche publiés, ce problème est connu sous le nom de « biais lié au cycle de vie ». Voir par exemple Grawe (2006), Haider et Solon (2006) et Gouskova, Chiteji et Stafford (2010).
3. Pour améliorer la mesure du revenu à vie des pères, on a calculé la moyenne de leurs revenus annuels de 35 à 55 ans, sous réserve d'un revenu positif pour au moins 10 de ces 21 années.
4. Voir par exemple Mazumder (2005).

La persistance intergénérationnelle tend à être plus élevée lorsqu'on mesure le revenu du marché et le revenu total. Ces deux mesures fournissent des renseignements supplémentaires sur les mécanismes de transmission d'une génération à l'autre. Il arrive que certains parents transmettent leurs entreprises ou leurs emplois à leurs descendants. L'élasticité intergénérationnelle estimée pour les pères et les fils est en effet plus élevée, soit d'environ 0,35, si l'on utilise la mesure du revenu du marché, ce qui indique que d'autres mécanismes comme la transmission des emplois ou des aptitudes entrepreneuriales pourraient intervenir.

Pour mesurer l'EIR en fonction du revenu total, les pères et les fils qui participent moins au marché du travail sont inclus dans l'analyse, à condition qu'ils reçoivent des transferts gouvernementaux de n'importe quel ordre (échelon local ou national). Si les fils de pères à faible revenu sont plus susceptibles de recevoir de l'aide gouvernementale, cela pourrait se refléter dans les estimations de l'EIR. La persistance intergénérationnelle s'accroît, bien que de façon modérée, à 0,36 lorsqu'on observe le revenu total.

La progression de la persistance intergénérationnelle constatée entre les mesures des gains et les mesures du revenu n'a toutefois pas été observée dans l'étude antérieure. Cela pourrait s'expliquer, entre autres, par le fait que les fils qui sont devenus travailleurs indépendants plus tard dans la vie n'avaient pas encore démarré leur propre entreprise (ou venaient de le faire) au début de la trentaine. Par conséquent, le biais découlant de la variation liée au cycle de vie peut être plus prononcé pour le revenu que pour les gains.

Graphique 1
Relation entre le revenu à vie des fils et des pères, mesurée par l'élasticité intergénérationnelle du revenu



Notes : Les gains comprennent les traitements et les salaires. Le revenu du marché comprend les gains plus les revenus d'un travail indépendant et de placements. Le revenu total comprend le revenu du marché plus les transferts gouvernementaux. M. Corak et A. Heisz, 1999, « The Intergenerational Earnings and Income Mobility of Canadian Men: Evidence from Longitudinal Icome Tax Data ».
Source : Statistique Canada, calculs des auteurs fondés sur la base de données sur la mobilité intergénérationnelle du revenu.

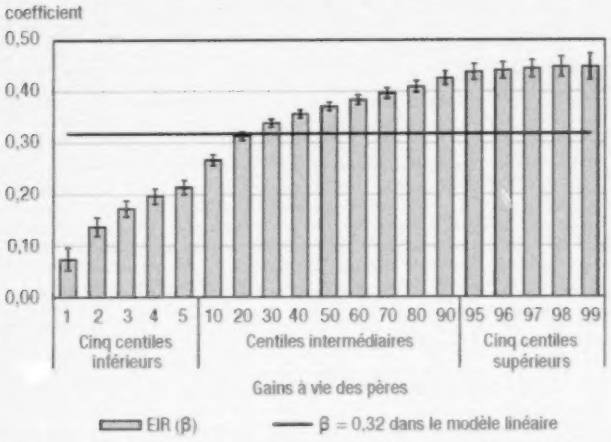
En règle générale, la transmission intergénérationnelle des gains et du revenu est plus faible pour les filles que pour les garçons. L'examen des paires père-fille a révélé une élasticité estimée d'environ 0,23 pour les gains et de 0,24 à 0,25 pour le revenu. Ces chiffres semblent indiquer que les résultats des filles dépendent moins des gains et du revenu de leur père que ceux des fils. Ces estimations sont comparables à celles qui ont été obtenues dans le cadre d'études antérieures. Contrairement aux estimations visant les paires père-fils, les estimations de l'EIR pour les paires père-fille ne semblent pas être influencées par l'âge auquel on observe les gains et le revenu des filles. En fait, les estimations fondées sur les gains des filles à 30 ans sont très semblables à celles qui reposent sur les gains des filles à 40 ans.

Plusieurs facteurs peuvent expliquer ce résultat. En règle générale, les femmes sont plus susceptibles que les hommes d'interrompre leur carrière pour avoir des enfants et les élever durant les premières années de leur vie active. Les constatations correspondent également aux résultats obtenus dans d'autres pays quant au rôle de l'« appariement assortatif », que les chercheurs ont désigné comme l'une des raisons possibles pour expliquer l'EIR plus faible pour les filles. Lorsqu'il y a assortiment conjugal, les filles ayant des perspectives de gains élevés sont plus susceptibles d'épouser un homme ayant des gains élevés et pourraient choisir de travailler un moins grand nombre d'heures ou accepter une rémunération plus faible afin d'atteindre un meilleur équilibre entre la vie professionnelle et la vie familiale. Lorsqu'il y a appariement assortatif, les gains à vie du père pourraient être plus étroitement liés aux gains familiaux des filles (y compris ceux du conjoint) plutôt qu'à leurs propres gains. Le reste de la présente analyse ne porte que sur les pères et les fils.

La mobilité n'est pas la même dans toute la population

Les tendances moyennes en matière de mobilité présentées plus haut masquent l'hétérogénéité dans la population. Dans la répartition des gains, le degré de mobilité intergénérationnelle des gains au Canada est caractérisé par une tendance non linéaire marquée (graphique 2). La persistance des gains est assez faible pour les fils des centiles inférieurs de la répartition des gains des pères (c.-à-d. en deçà de 0,2), ce qui semble indiquer une mobilité vers le haut assez importante pour les fils ayant un père dont les gains sont très faibles. En revanche, la persistance des gains est forte pour les fils se trouvant à l'autre extrémité de la répartition. L'élasticité intergénérationnelle estimée atteint 0,44 ou plus pour les cinq centiles supérieurs des gains des pères, ce qui indique que près de la moitié de l'avantage salarial des pères ayant les gains les plus élevés est transmise aux fils.

Graphique 2
Relation non linéaire entre les gains à vie des fils et des pères, mesurée par l'élasticité intergénérationnelle du revenu (EIR)



Notes : Les gains à vie sont établis en calculant les moyennes des gains des pères de 35 à 55 ans et des gains des fils de 38 à 42 ans. Les lignes d'erreur verticales superposées aux barres représentent les intervalles de confiance (IC) à 95 %. Les IC indiquent le degré de variabilité de l'estimation et permettent des comparaisons plus valables des différences entre les estimations.
Source : Statistique Canada, calculs des auteurs fondés sur la base de données sur la mobilité intergénérationnelle du revenu.

Les tendances canadiennes en matière de mobilité ressemblent plus à celles des pays nordiques qu'à celles des États-Unis

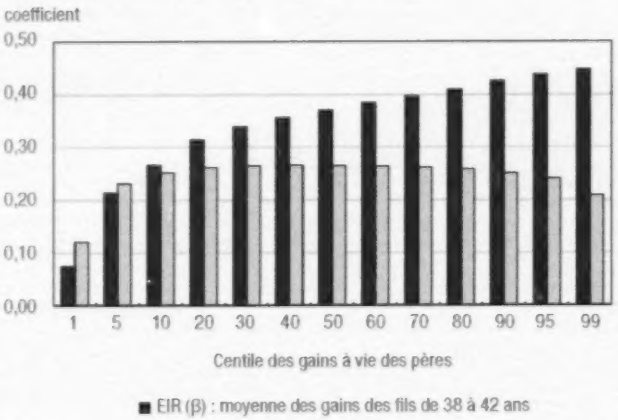
La tendance à la non-linéarité constatée dans les données canadiennes semble mieux correspondre à ce qui a été observé dans les pays nordiques : une relation intergénérationnelle modeste dans les segments inférieurs de la répartition des gains des pères et une corrélation de plus en plus positive dans les segments intermédiaires et supérieurs (Bratsberg et coll., 2007). Aux États-Unis, en revanche, on constate une relation presque parfaitement linéaire entre les rangs des enfants et ceux des parents dans la répartition du revenu (Chetty et coll., 2014).

Bien que le présent article n'examine pas les raisons précises pour lesquelles la mobilité varie dans l'ensemble de la répartition, les études réalisées dans les pays nordiques indiquent que la mobilité plus élevée dans le bas de la répartition pourrait s'expliquer par des facteurs institutionnels. Bratsberg et coll. (2007), en particulier, soutiennent que les systèmes d'éducation et de bien-être social en vigueur dans les pays nordiques favorisent la mobilité vers le haut des jeunes dont les parents ont peu de ressources. Les facteurs parentaux qui influent sur la mobilité dans les segments supérieurs pourraient être encore plus complexes. Les facteurs importants abordés dans les rapports de recherche comprennent les emplois, le réseautage et le capital propre à chaque famille (Björklund, Roine et Waldenström, 2012; Corak et Piraino, 2011; Kramarz et Skans, 2014).

Des données sur le revenu couvrant une longue période du cycle de vie sont essentielles à une analyse intergénérationnelle

L'une des contributions les plus importantes du présent article est de montrer que les estimations de l'EIR sont très différentes lorsque le revenu des enfants est mesuré au début de leur vie active plutôt qu'à la mi-carrière. Cette situation a donné lieu à une sous-évaluation de la persistance moyenne au fil des générations (comme on peut le voir au graphique 1). Elle a aussi une incidence considérable sur les estimations de l'EIR à différents points dans la répartition du revenu. La distorsion est probablement plus grande dans les segments supérieurs de la répartition, puisque la plupart des enfants destinés à devenir des adultes ayant des gains élevés n'ont pas encore atteint leur plein potentiel de gains lorsqu'ils sont encore jeunes. De fait, le tableau 3 révèle une tendance de non-linéarité très différente lorsqu'on observe les gains des fils à l'âge de 38 à 42 ans plutôt qu'à 30 ans. En raison de la variation liée au cycle de vie, l'importance de la corrélation entre les gains des pères et ceux des fils tend à être sous-estimée dans pratiquement toute la répartition des gains des pères, la distorsion étant plus grande dans la partie supérieure de la répartition. L'élasticité estimée au 95e centile, par exemple, n'est que de 0,24 lorsqu'on la calcule à partir des gains des fils à 30 ans. Cette valeur est inférieure d'environ 45 % à l'estimation calculée à partir des gains des fils à l'âge de 38 à 42 ans (qui s'établit à 0,44).

Graphique 3
Relation non linéaire entre les gains à vie des fils et des pères, selon deux scénarios, mesurée par l'élasticité intergénérationnelle du revenu (EIR)



Source : Statistique Canada, calculs des auteurs fondés sur la base de données sur la mobilité intergénérationnelle du revenu.

Conclusion

Deux conclusions ressortent de la présente étude.

Tout d'abord, même si le Canada demeure une société mobile, il ne l'est pas autant qu'on le croyait. L'élasticité intergénérationnelle du revenu au Canada est estimée à environ 0,32, ce qui indique qu'environ le tiers de la différence entre les revenus d'une génération est transmis à la suivante. Cette valeur est plus élevée que l'estimation de 0,2 obtenue dans le cadre de recherches antérieures au Canada.

Ensuite, l'ampleur de la mobilité intergénérationnelle du revenu n'est pas la même pour tous. En règle générale, la transmission intergénérationnelle des gains et du revenu est plus faible pour les filles que pour les fils. En outre, la persistance du revenu est beaucoup plus forte au sommet de la répartition du revenu, ce qui permet de penser qu'il est plus difficile d'atteindre les niveaux supérieurs pour les enfants dont le père n'appartient pas déjà à un segment de revenu supérieur. En revanche, on constate clairement une bonne part de mobilité générationnelle chez les fils de pères ayant un très faible revenu.

Bibliographie

Björklund, A., J. Roine et D. Waldenström. 2012. « Intergenerational top income mobility in Sweden: Capitalistic dynasties in the land of equal opportunity? ». *Journal of Public Economics* 96 (5-6) : 474 à 484.

Bratsberg, B., K. Roed, O. Raaum, R. Naylor, M. Jäntti, T. Eriksson et E. Österbacka. 2007. « Nonlinearities in Intergenerational Earnings Mobility: Consequences for Cross-country Comparisons ». *The Economic Journal* 117 : C72 à 92.

Chen, W.-H., Y. Ostrovsky et P. Piraino. 2016. *Transmission intergénérationnelle du revenu : nouvelles données pour le Canada*. Direction des études analytiques : documents de recherche, nº 379. Produit nº 11F0019M au catalogue de Statistique Canada. Ottawa : Statistique Canada.

Chetty, R., N. Hendren, P. Kline et E. Saez. 2014. « Where is the Land of Opportunity? The Geography of Intergenerational Mobility in the United States ». *The Quarterly Journal of Economics* 129 (4) : 1553 à 1623.

Corak, M., et A. Heisz. 1999. « The Intergenerational Earnings and Income Mobility of Canadian Men: Evidence from Longitudinal Income Tax Data ». *The Journal of Human Resources* 34 (3) : 504 à 533.

Corak, M., et P. Piraino. 2011. « The Intergenerational Transmission of Employers ». *Journal of Labor Economics* 29 (1) : 37 à 68.

Gouskova, E., N. Chiteji et F. Stafford. 2010. « Estimating the intergenerational persistence of lifetime earnings with life course matching: Evidence from the PSID ». *Labour Economics* 17 (3) : 592 à 597.

Grawe, N.D. 2006. « Lifecycle bias in estimates of intergenerational earnings persistence ». *Labour Economics* 13 (5) : 551 à 570.

Haider, S., et G. Solon. 2006. « Life-cycle Variation in the Association between Current and Lifetime Earnings ». *The American Economic Review* 96 (4) : 1308 à 1320.

Kramarz, F., et O.N. Skans. 2014. « When Strong Ties are Strong: Networks and Youth Labour Market Entry ». *The Review of Economic Studies* 81 : 1164 à 1200.

Mazumder, B. 2005. « Fortunate Sons: New Estimates of Intergenerational Mobility in the United States Using Social Security Earnings Data ». *The Review of Economics and Statistics* 87 (2) : 235 à 255.